

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要

(上接 D6 版)

14. 监察稽核部对投资流程的合法合规性进行监控。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：新华富时 600 成长指数 × 70% + 新华富时中国综合债券指数 × 30%。在合理的市场化利率基准推出等客观情况的影响下，基金管理人可根据投资目标和投资策略，确定变更业绩比较基准，此项变更无须召开基金份额持有人大会，但应及时公告。

新华富时 600 成长指数具有市场代表性强、指数编制方法透明、样本股票调整规则清晰、市场波动较小等特征。更具体而言，新华富时 600 成长指数具有如下特征：

1. 该指数的编制原则具有可公开获取、透明性的特点，同时指数由不参与资本市场运作的独立的指数编制公司—新华富时指数公司编制和管理，保证了指数独立客观的反映中国股票市场状况；

2. 新华富时指数系列已成为海内外最具影响力的中国指数系列，目前已覆盖了类型众多的机构投资者。

基于新华富时 600 成长指数的上述特征，本基金选择该指数作为衡量基金股票投资部分业绩的基准指数。

新华富时中国综合债券指数是业内最常用的一种评判债券投资收益的基准指数之一，它涵盖了我国三个市场（银行间市场、沪、深交易所）上市的可投资级的固定利率债券，在编制中的样本选择标准严格，再加上它具有权威性、便利性、及时性的特点，因此本基金选择新华富时中国综合债券指数作为基金债券投资部分的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征
本基金属于混合型（偏股票）基金，其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金、低风险型基金，为证券投资基金中的中高风险品种。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)
本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国农业银行根据本基金合同规定，已于 2008 年 1 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所列财务数据截至 2007 年 12 月 31 日，未经审计。

1. 截至 2007 年 12 月 31 日基金资产组合情况

2. 截至 2007 年 12 月 31 日按行业分类的股票投资组合

3. 截至 2007 年 12 月 31 日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

4. 截至 2007 年 12 月 31 日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细

5. 基金投资前五名债券明细

6. 报告附注

(1) 报告期内，本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

(2) 报告期内，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

其他资产明细 金额(元)

交易保证金 1,000,000.00

应收利息 7,349,978.96

应收申购款 34,049,350.60

应收证券清算款 338,682,463.84

合计 381,081,793.40

(4) 本报告期末本基金没有持有处于转股期的可转换债券，也没有投资资产支持证券、分离交易可转债。

7. 本基金权证投资情况及本报告期末本基金持有权证情况

权证名称 本报告期末买入权证金额(元) 本报告期末持仓权证市值(元) 报告期初持有权证市值(元) 报告期末持有权证市值(元) 报告期末权证市值占基金资产净值比例(%)

华侨城认购权证 59,968,243.55 0.00 0.00 0.00 0.00

五粮液认购权证 0.00 0.00 0.00 23,801,500.00 0.15

合计 59,968,243.55 0.00 0.00 23,801,500.00 0.15

本基金投资、持有权证的金額、比例等符合相关法律法规及中国证监会的相关规定。

十二、基金的业绩
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期业绩的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：

成立时间 净值增长 1 净值增长率标准差 2 业绩比较基准收益 3 业绩比较基准收益率标准差 4 1-3 2-4

过去一个月 13.62% 1.78% 8.59% 1.12% 5.03% 0.66%

过去三个月 -9.49% 1.96% -3.25% 1.23% -6.24% 0.63%

过去六个月 39.02% 2.04% 26.32% 1.40% 12.70% 0.64%

自基金合同生效至 2007 年 12 月 31 日 112.70% 2.01% 82.70% 1.54% 30.00% 0.47%

2. 基金合同生效以来基金资产净值变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。

注 1：业绩比较基准=中信综指 × 70% + 中信标普国债指数 × 30%。

注 2：本基金基金合同于 2007 年 1 月 9 日生效。

注 3：基金业绩截止日为 2007 年 12 月 31 日。

十三、基金的费用与税收

4. 截至 2007 年 12 月 31 日按债券分类的债券投资组合

序号 债券品种 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)

1 国债 0.00 0.00

2 金融债 483,870,000.00 3.11

3 企业债 0.00 0.00

4 可转换债券 996,402.00 0.01

合计 484,866,402.00 3.12

5. 截至 2007 年 12 月 31 日按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号 债券名称 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)

1 07 央票 15 291,630,000.00 1.87

2 07 央票 139 192,240,000.00 1.24

3 唐钢转债 996,402.00 0.01

注：上述债券明细为本基金截止本报告期末投资的全部债券。

6. 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的股票。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

其他资产明细 金额(元)

交易保证金 1,000,000.00

应收利息 7,349,978.96

应收申购款 34,049,350.60

应收证券清算款 338,682,463.84

合计 381,081,793.40

(4) 本报告期末本基金没有持有处于转股期的可转换债券，也没有投资资产支持证券、分离交易可转债。

7. 本基金权证投资情况及本报告期末本基金持有权证情况

权证名称 本报告期末买入权证金额(元) 本报告期末持仓权证市值(元) 报告期初持有权证市值(元) 报告期末持有权证市值(元) 报告期末权证市值占基金资产净值比例(%)

华侨城认购权证 59,968,243.55 0.00 0.00 0.00 0.00

五粮液认购权证 0.00 0.00 0.00 23,801,500.00 0.15

合计 59,968,243.55 0.00 0.00 23,801,500.00 0.15

本基金投资、持有权证的金額、比例等符合相关法律法规及中国证监会的相关规定。

十二、基金的业绩
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期业绩的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：

成立时间 净值增长 1 净值增长率标准差 2 业绩比较基准收益 3 业绩比较基准收益率标准差 4 1-3 2-4

过去一个月 13.62% 1.78% 8.59% 1.12% 5.03% 0.66%

过去三个月 -9.49% 1.96% -3.25% 1.23% -6.24% 0.63%

过去六个月 39.02% 2.04% 26.32% 1.40% 12.70% 0.64%

自基金合同生效至 2007 年 12 月 31 日 112.70% 2.01% 82.70% 1.54% 30.00% 0.47%

2. 基金合同生效以来基金资产净值变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。

注 1：业绩比较基准=中信综指 × 70% + 中信标普国债指数 × 30%。

注 2：本基金基金合同于 2007 年 1 月 9 日生效。

注 3：基金业绩截止日为 2007 年 12 月 31 日。

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费；

(2) 基金托管人的托管费；

(3) 基金合同生效后的信息披露费用；

(4) 基金合同生效后的审计费用；

(5) 基金份额持有人大会费用；

(6) 基金合同生效后的会计师费和律师费；

(7) 基金的证券交易费用；

(8) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法律法规和基金合同、招募说明书等法律文件的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费
基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：
H = E × 1.5% × 当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费
基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：
H = E × 0.25% × 当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 本条第 1 款第(3)至第(8)项费用由基金管理人或基金托管人根据有关协议、中国证监会的规章及相关法规的规定，按费用实际支出金额支付，列入或列入当期基金费用。

(二) 与销售有关的费用

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本